공시일	2017-08-18
기준일	2017-08-17

포커스농산물모(채권-파생평)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	8	0	8	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2017-08-18
기준일	2017-08-17

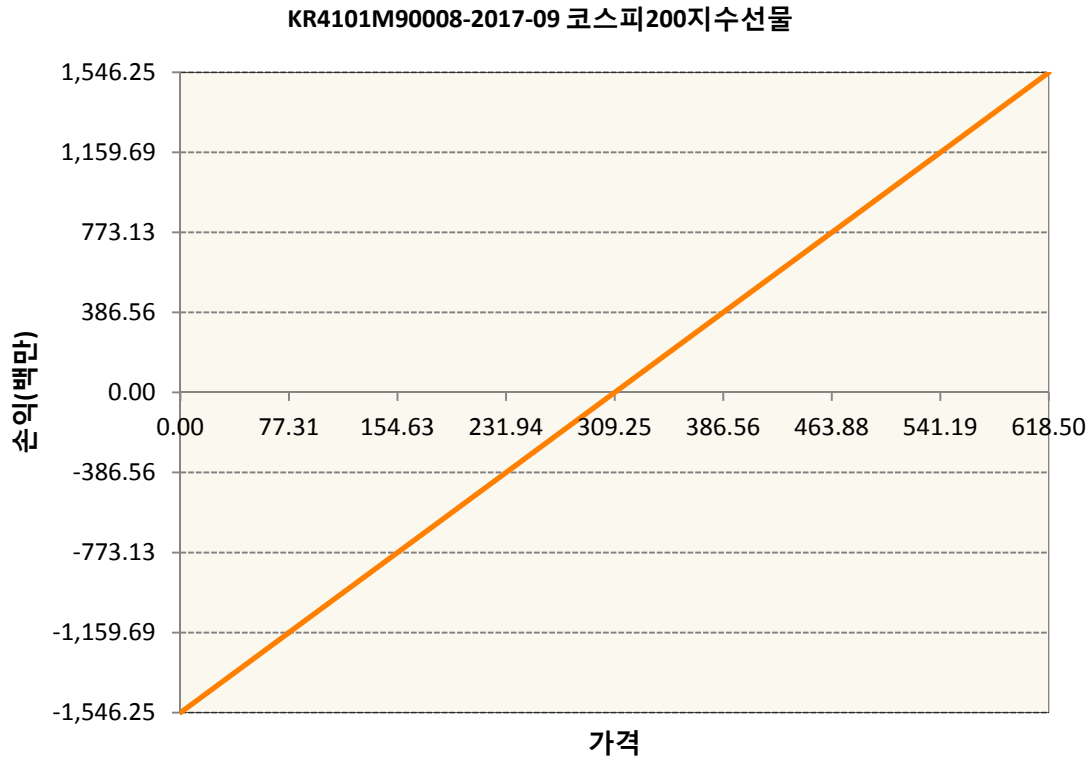
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,546	0	1,546	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							124
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	124	124	124	124	124	124	124

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

77

공시일	2017-08-18
기준일	2017-08-17

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	12,360	0	12,360	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S170523	1,019

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

470

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-18
기준일	2017-08-17

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,599	0	4,599	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S170608	402

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

348

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-18
기준일	2017-08-17

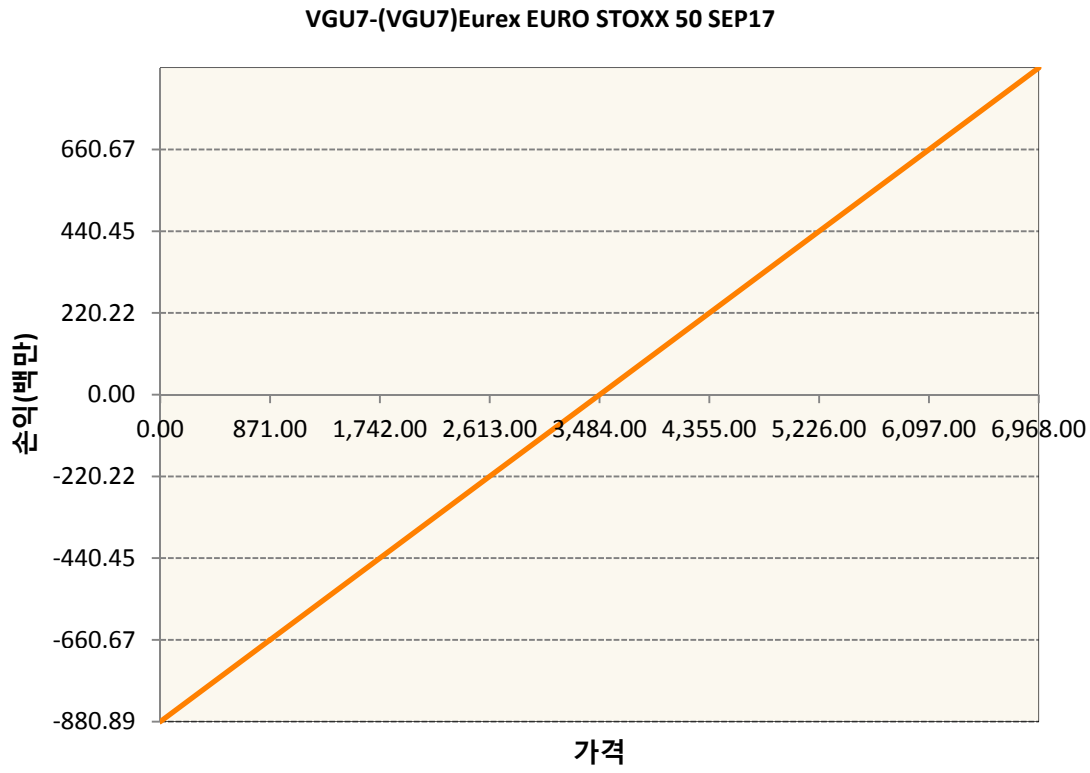
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	881	0	881	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	70

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

58

공시일	2017-08-18
기준일	2017-08-17

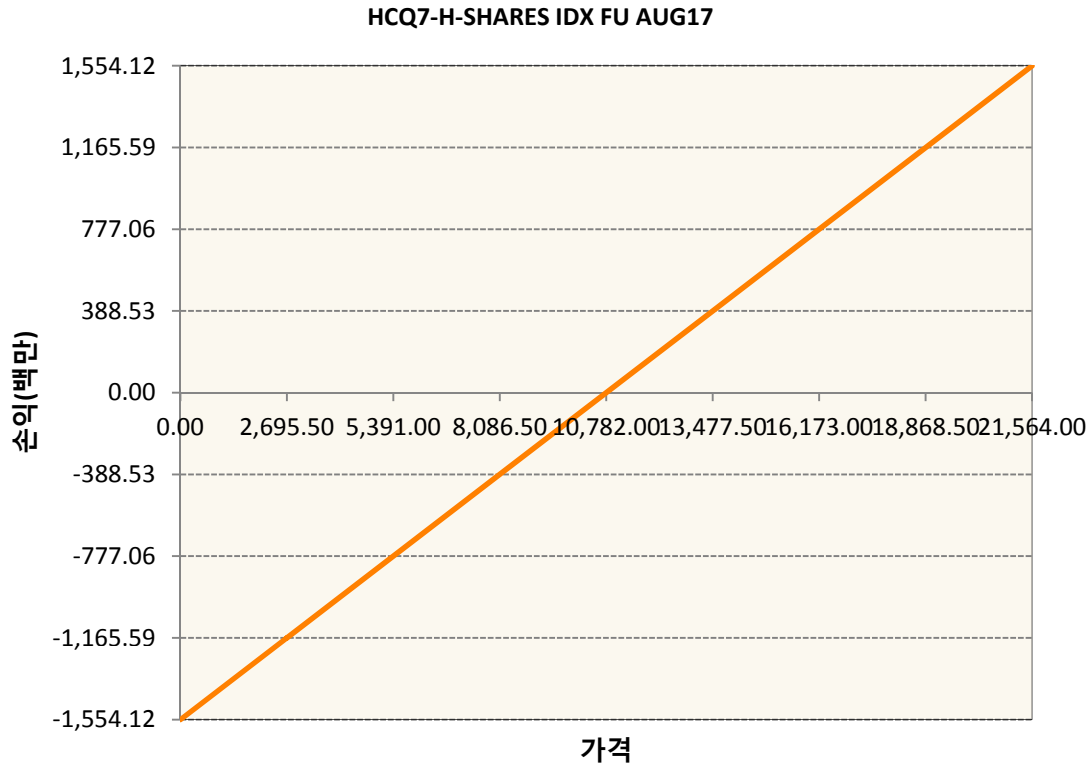
차이나인덱스모(주식-파생형)

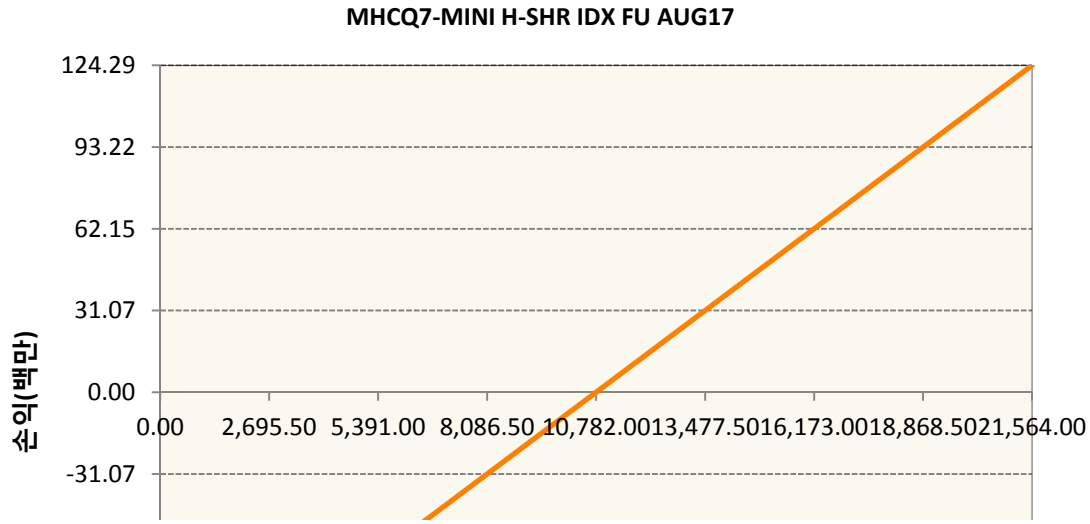
1. 계약금액

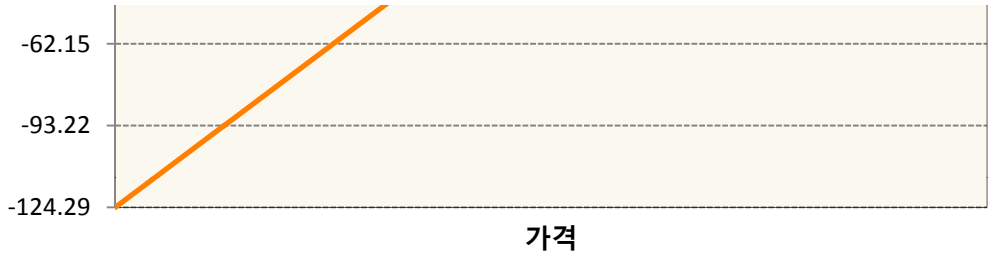
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,678	0	1,678	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ7	H-SHARES IDX FU AUG17	124
MHCQ7	MINI H-SHR IDX FU AUG17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	116

공시일	2017-08-18
기준일	2017-08-17

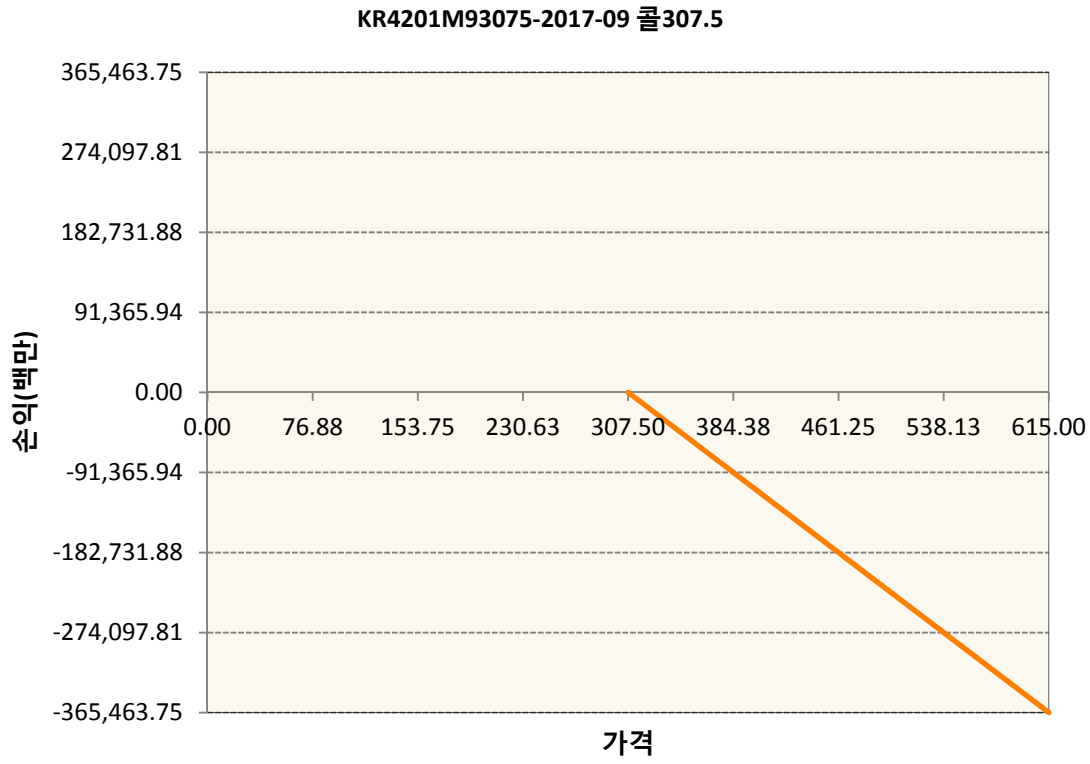
커버드콜모(주식혼합-파생형)

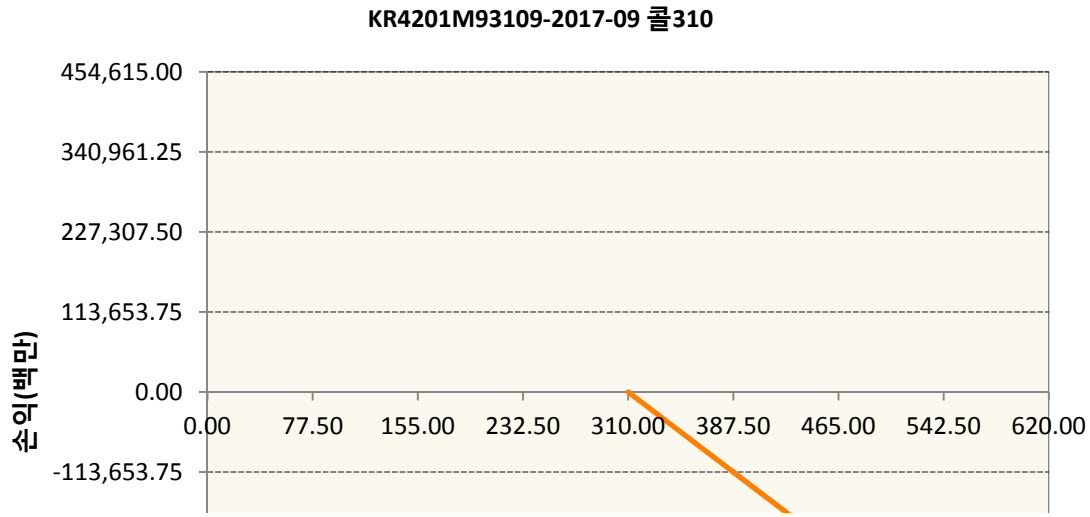
1. 계약금액

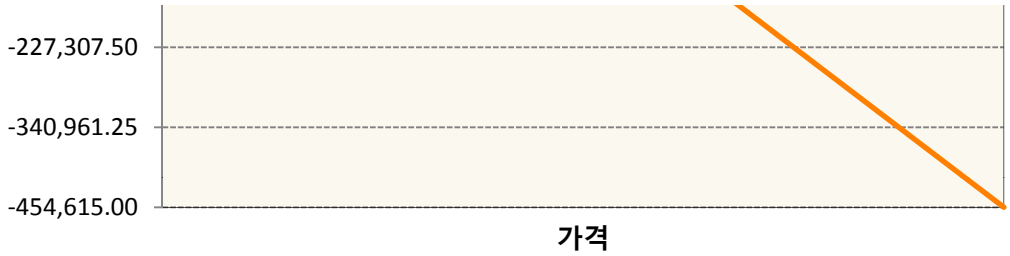
(단위:백만원)

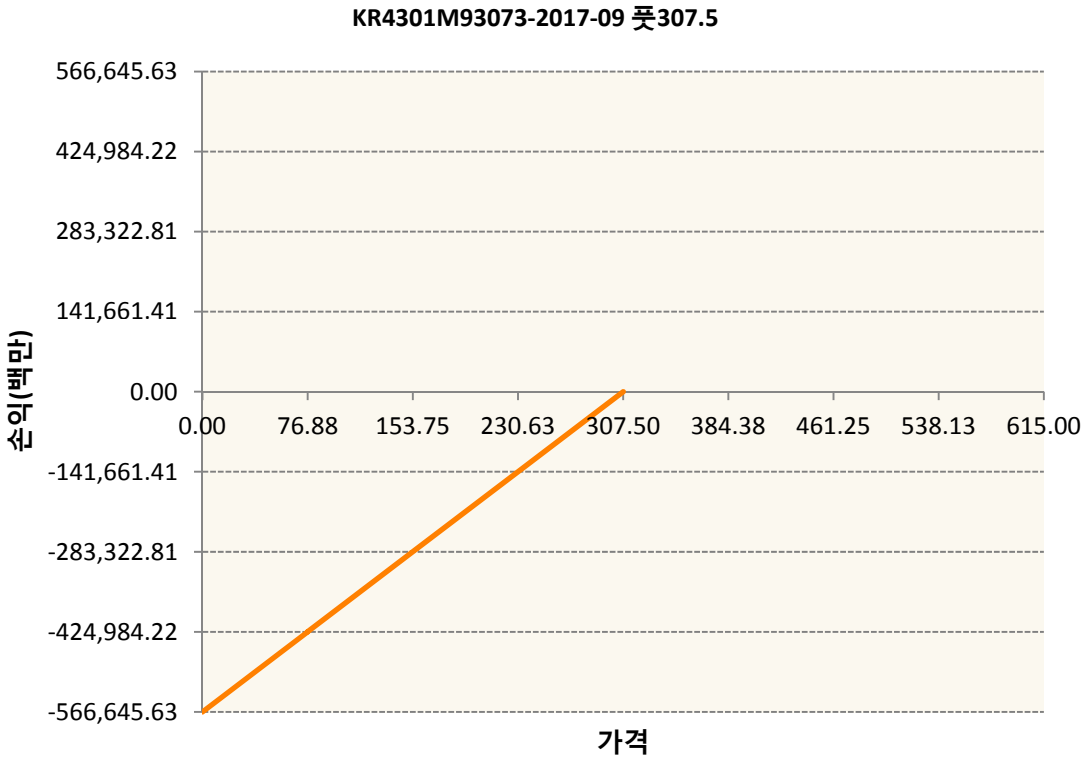
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	23,456	-23,456	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,435,472	-1,435,472	장내

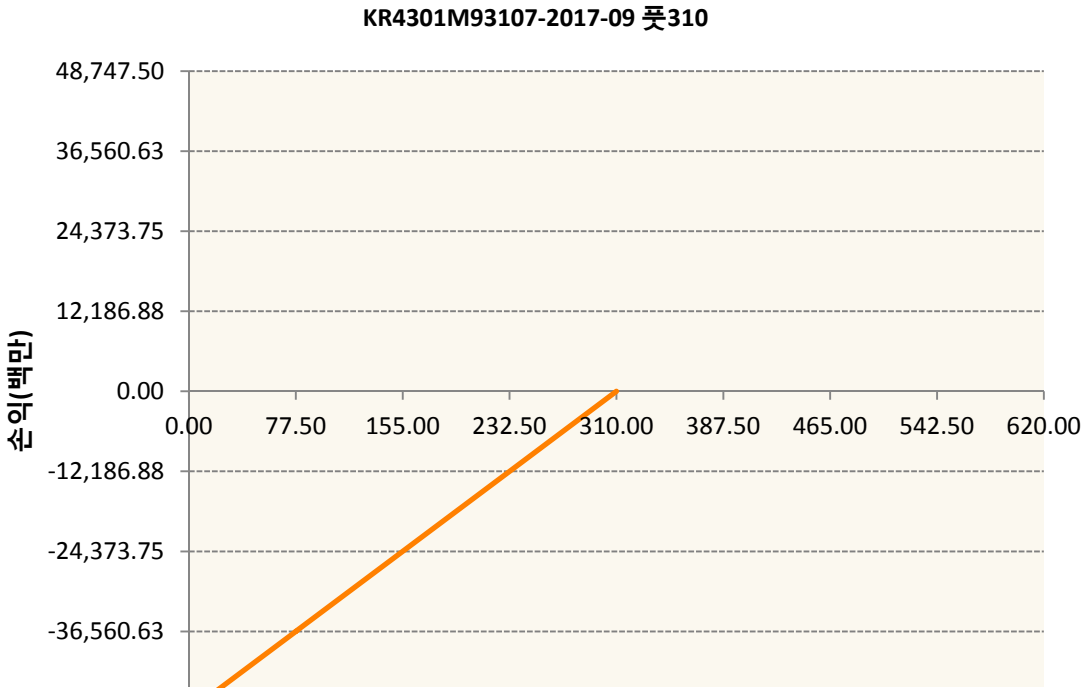
2. 만기시점의 손익구조

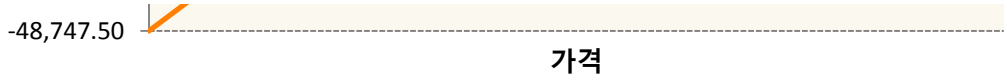





-227,307.50
-340,961.25
-454,615.00
가격


KR4301M93073-2017-09 풋307.5
566,645.63
424,984.22
283,322.81
141,661.41
0.00
-141,661.41
-283,322.81
-424,984.22
-566,645.63
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
615.00
손익(백만)
가격


KR4301M93107-2017-09 풋310
48,747.50
36,560.63
24,373.75
12,186.88
0.00
-12,186.88
-24,373.75
-36,560.63
0.00
77.50
155.00
232.50
310.00
387.50
465.00
542.50
620.00
손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201M93(2017-09 콜307.5							23,320
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,831	9,614	9,343	9,022	8,658	8,255	7,818
-5.33%	8,894	8,437	7,938	7,403	6,840	6,254	5,648
-2.67%	6,595	5,905	5,203	4,492	3,774	3,049	2,321
0%	2,302	1,535	768	0	-768	-1,537	-2,305
2.67%	-4,109	-4,752	-5,418	-6,102	-6,800	-7,509	-8,227
5.33%	-12,195	-12,610	-13,077	-13,587	-14,132	-14,707	-15,307
8.00%	-21,282	-21,493	-21,762	-22,084	-22,455	-22,869	-23,320
KR4201M93: 2017-09 콜310							27,551
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,470	10,264	9,993	9,662	9,275	8,837	8,355
-5.33%	9,622	9,147	8,610	8,021	7,391	6,724	6,027
-2.67%	7,370	6,584	5,773	4,941	4,093	3,233	2,362
0%	2,859	1,906	953	0	-953	-1,907	-2,860
2.67%	-4,283	-5,152	-6,039	-6,938	-7,847	-8,765	-9,689
5.33%	-13,697	-14,307	-14,972	-15,682	-16,427	-17,202	-18,001
8.00%	-24,598	-24,934	-25,343	-25,817	-26,348	-26,928	-27,551
KR4301M93(2017-09 풋307.5							33,380
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30,260	-30,597	-31,017	-31,514	-32,078	-32,703	-33,380
-5.33%	-16,545	-17,253	-18,028	-18,857	-19,729	-20,639	-21,578
-2.67%	-4,942	-6,011	-7,100	-8,202	-9,316	-10,439	-11,569
0%	3,570	2,381	1,191	0	-1,191	-2,383	-3,575
2.67%	8,796	7,799	6,766	5,706	4,624	3,525	2,411
5.33%	11,427	10,783	10,059	9,269	8,424	7,532	6,602
8.00%	12,506	12,178	11,761	11,261	10,686	10,045	9,345
KR4301M93: 2017-09 풋310							2,987
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,760	-2,782	-2,811	-2,847	-2,888	-2,935	-2,987
-5.33%	-1,557	-1,608	-1,665	-1,728	-1,796	-1,868	-1,942
-2.67%	-504	-588	-675	-765	-855	-948	-1,041
0%	307	204	102	0	-102	-204	-307
2.67%	835	742	647	550	453	354	255

5.33%	1,120	1,054	983	907	827	744	658
8.00%	1,245	1,209	1,165	1,115	1,058	996	929

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

84,963

공시일	2017-08-18
기준일	2017-08-17

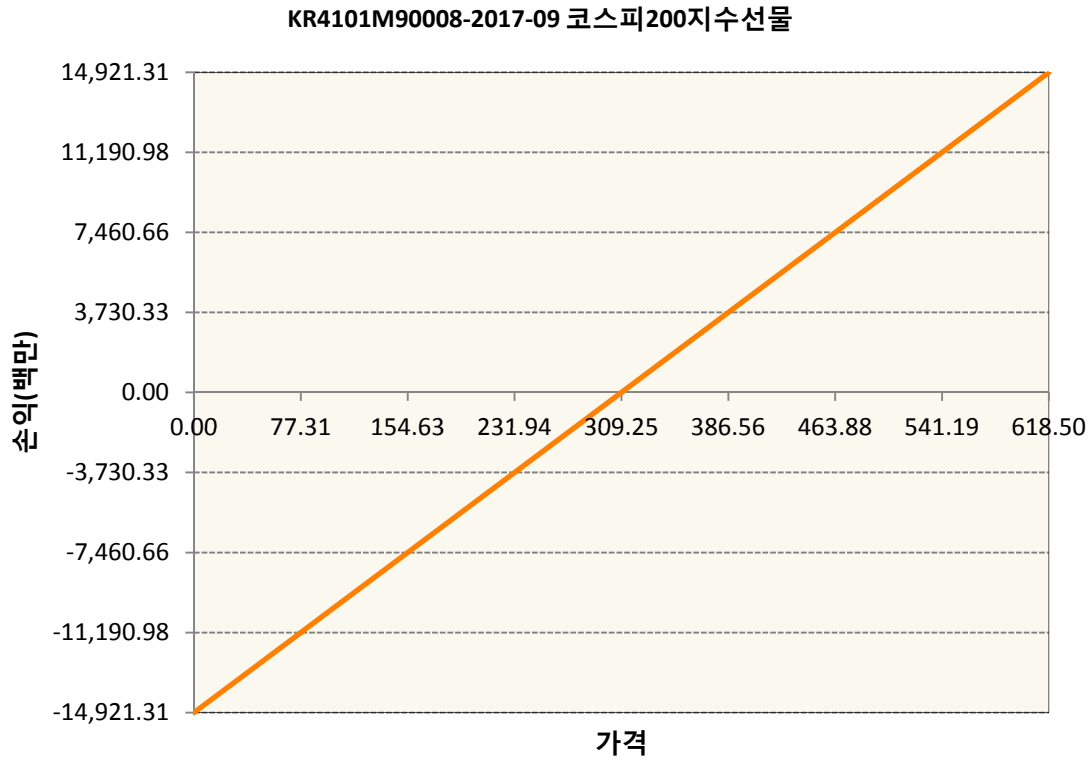
ETF스마트레버리지목표전환형6호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	14,921	0	14,921	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							1,193
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193
-5.33%	-795	-795	-795	-795	-795	-795	-795
-2.67%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	398	398	398	398	398	398	398
5.33%	795	795	795	795	795	795	795
8.00%	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

745

공시일	2017-08-18
기준일	2017-08-17

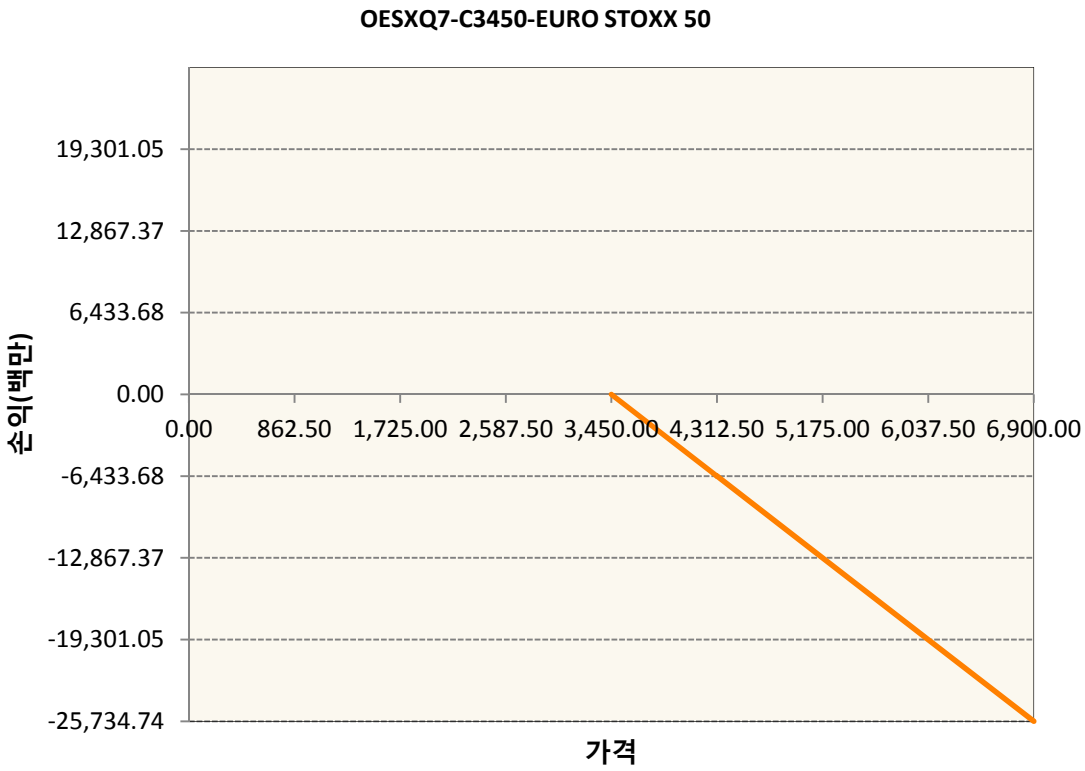
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

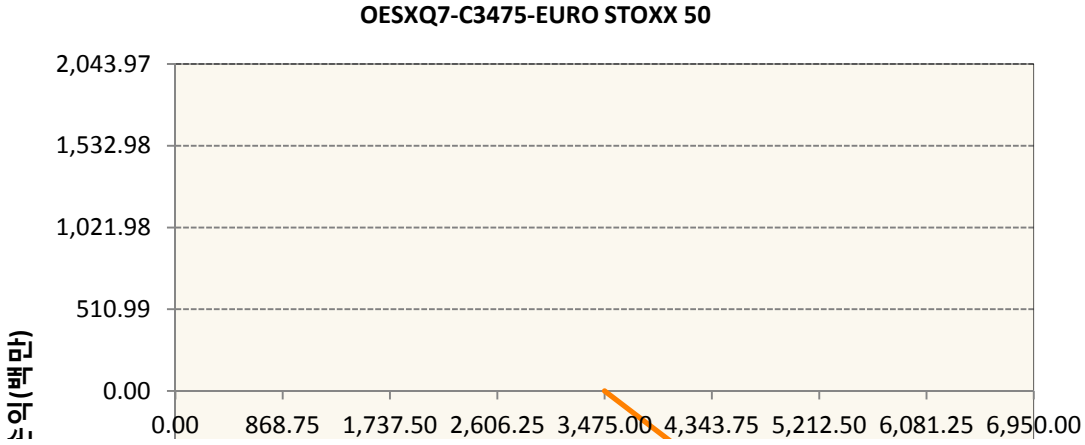
1. 계약금액

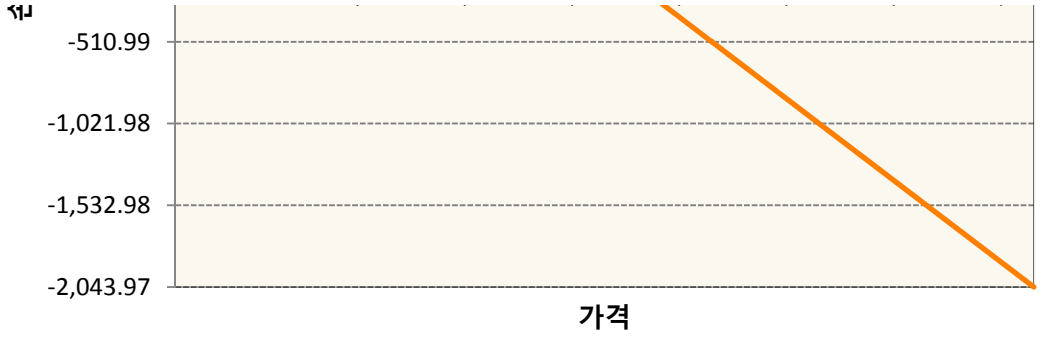
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	24,876	0	24,876	
누계	유가증권	옵션	0	55,557	-55,557	장내

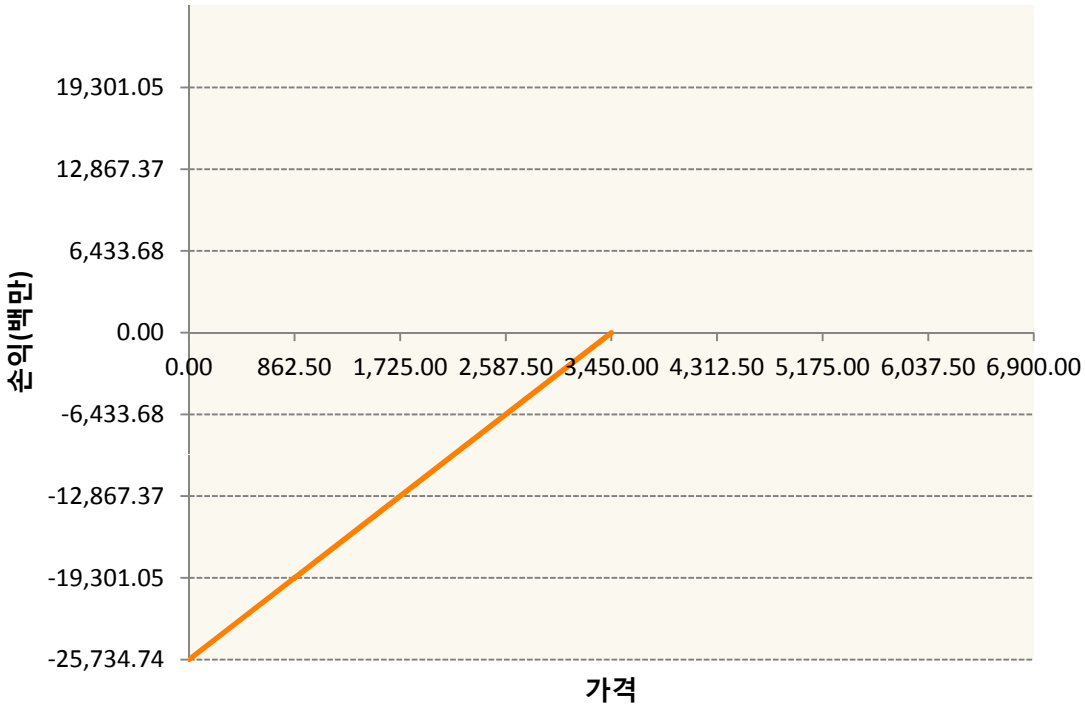
2. 만기시점의 손익구조



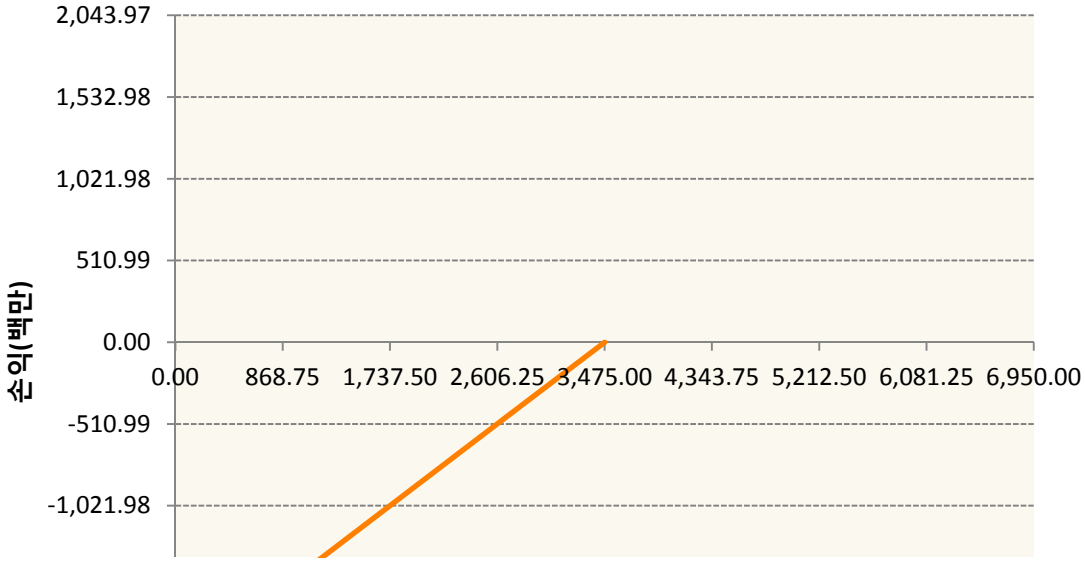


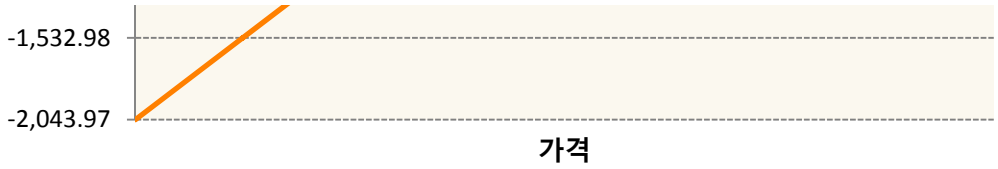


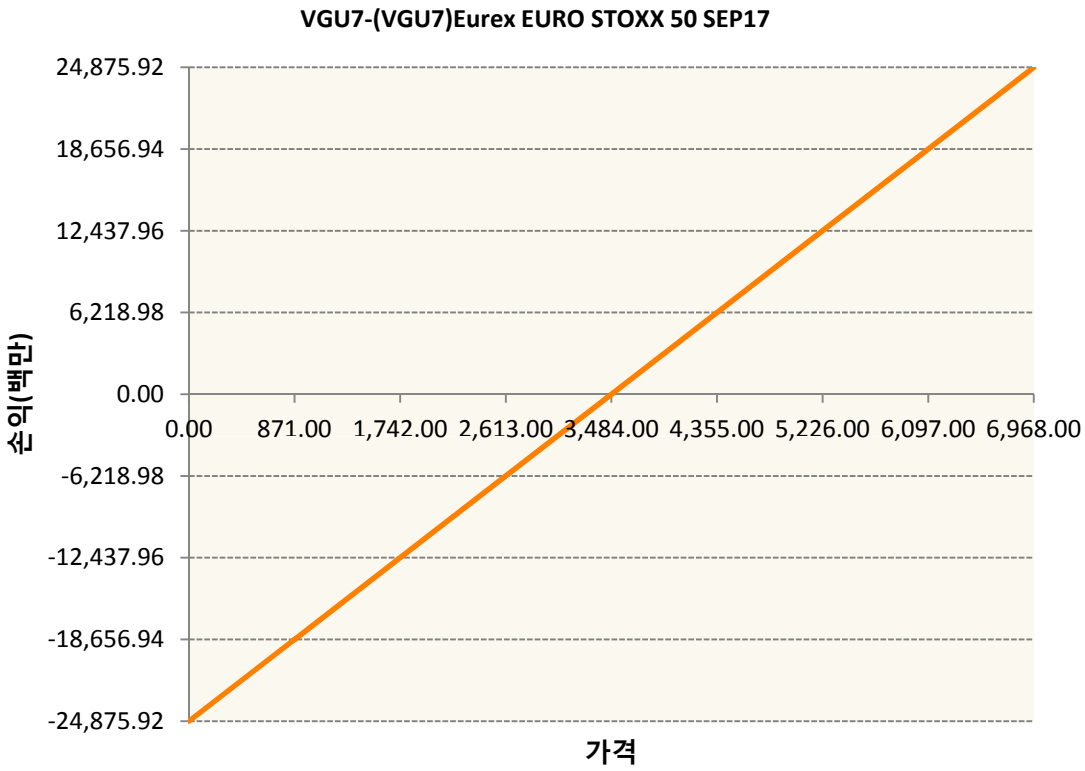
OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50



OESXQ7-P3475-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	2,059
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	164
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	2,059
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	164
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,990

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

5,254

공시일	2017-08-18
기준일	2017-08-17

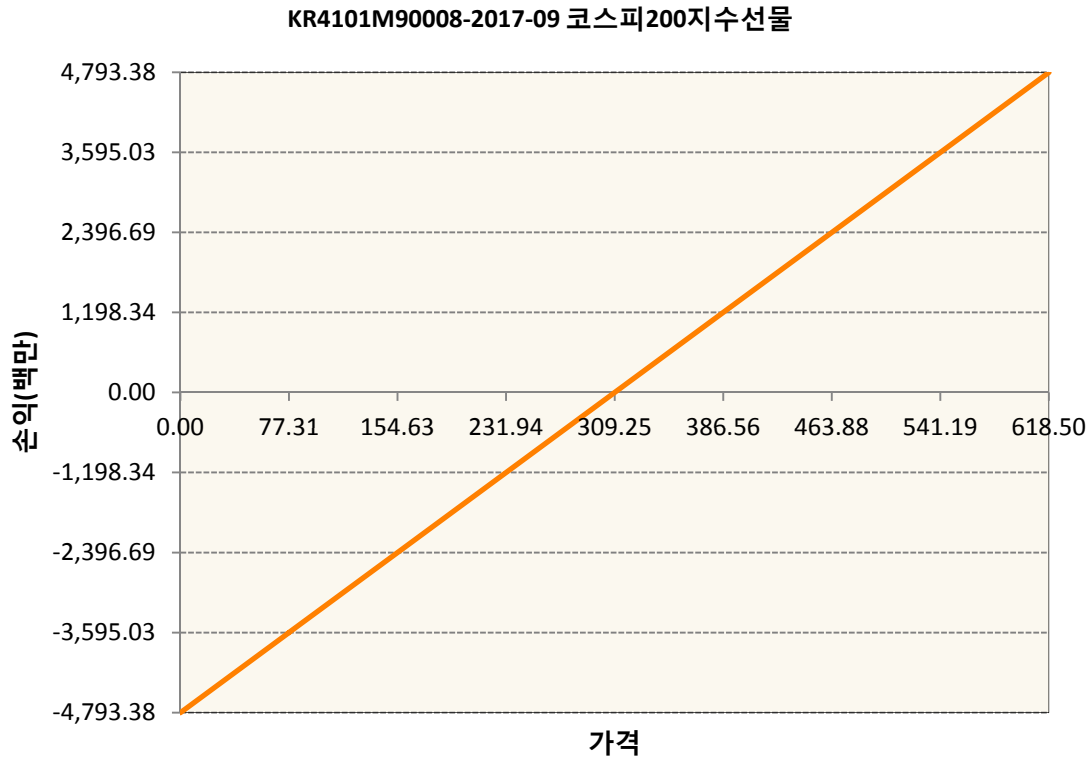
ETF스마트레버리지목표전환형7호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,793	0	4,793	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							383
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-383	-383	-383	-383	-383	-383	-383
-5.33%	-255	-255	-255	-255	-255	-255	-255
-2.67%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	128	128	128	128	128	128	128
5.33%	255	255	255	255	255	255	255
8.00%	383	383	383	383	383	383	383

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

239

공시일	2017-08-18
기준일	2017-08-17

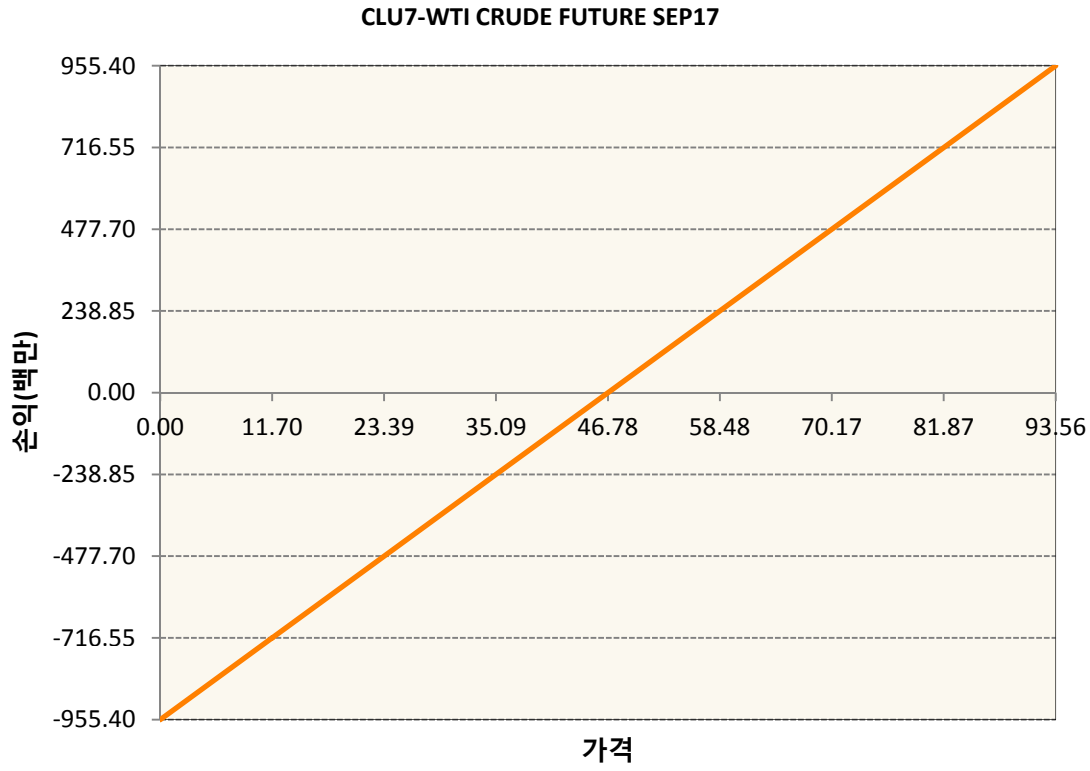
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

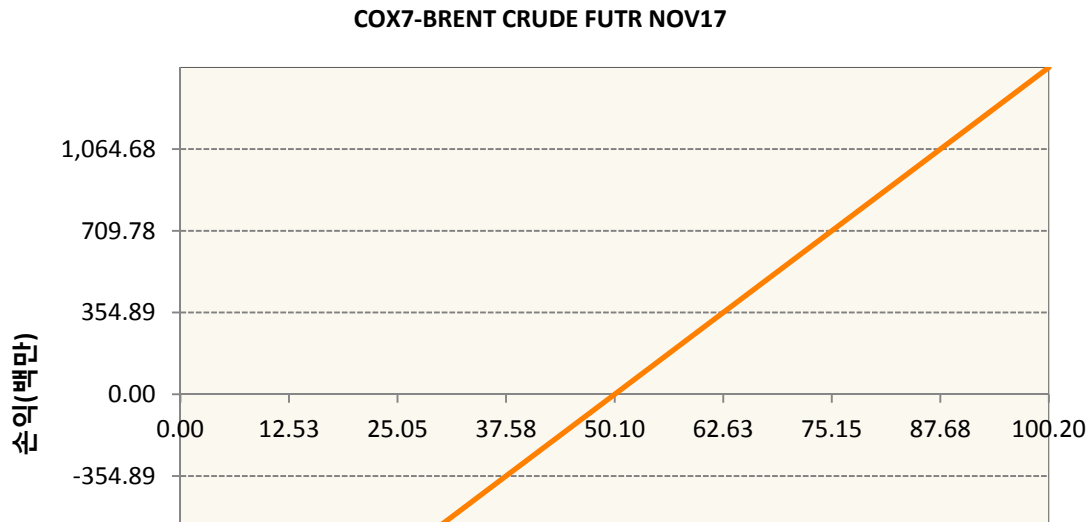
1. 계약금액

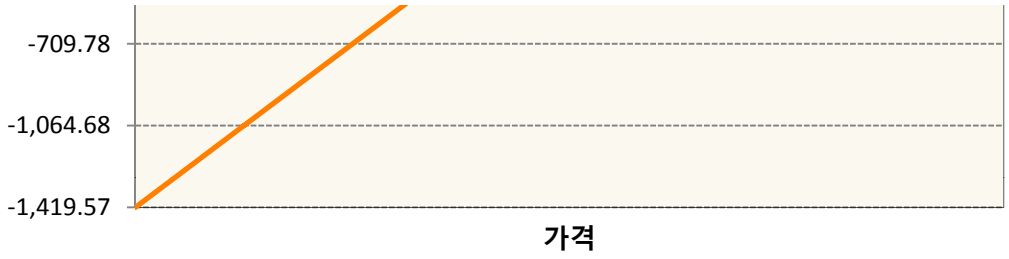
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,250	341	4,909	

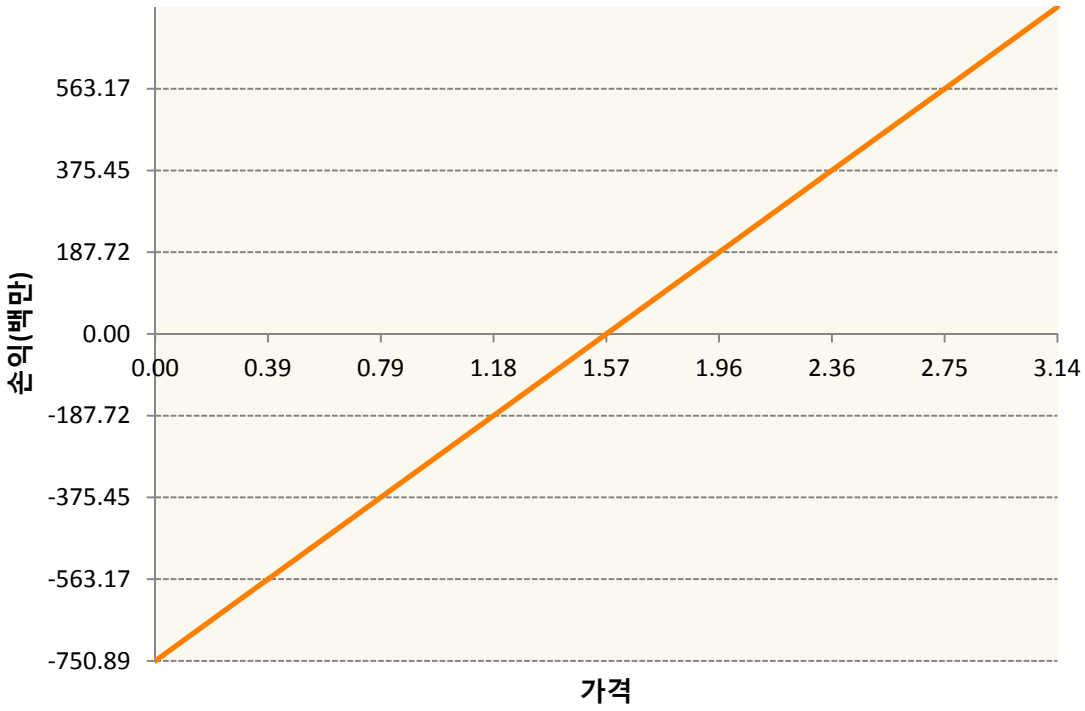
2. 만기시점의 손익구조



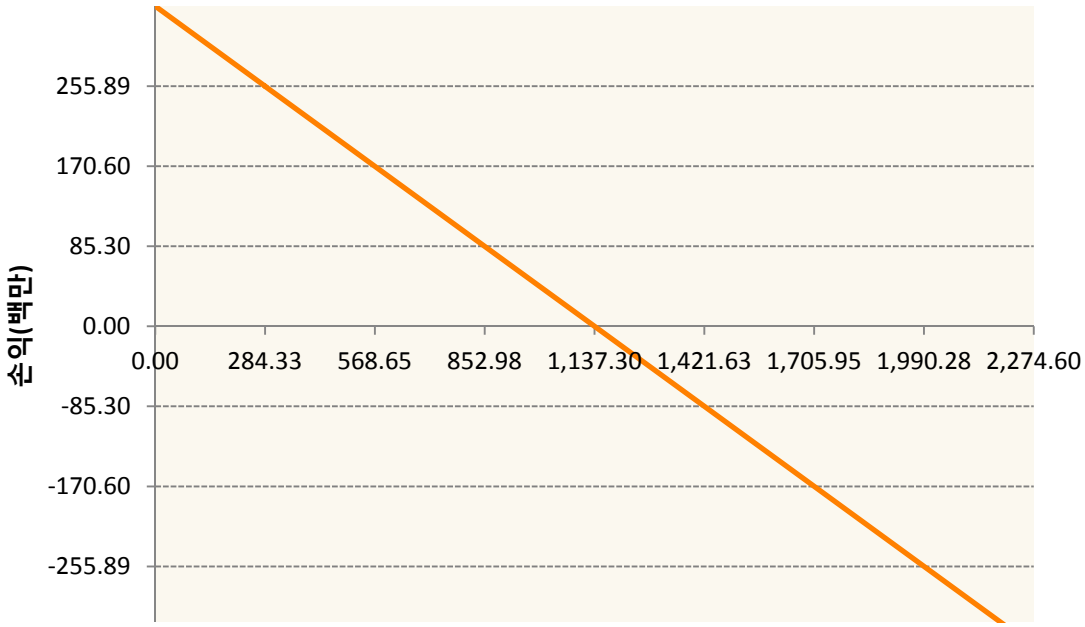


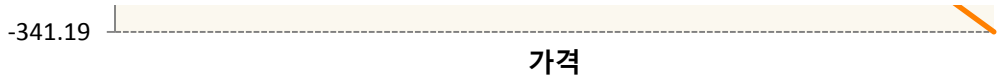


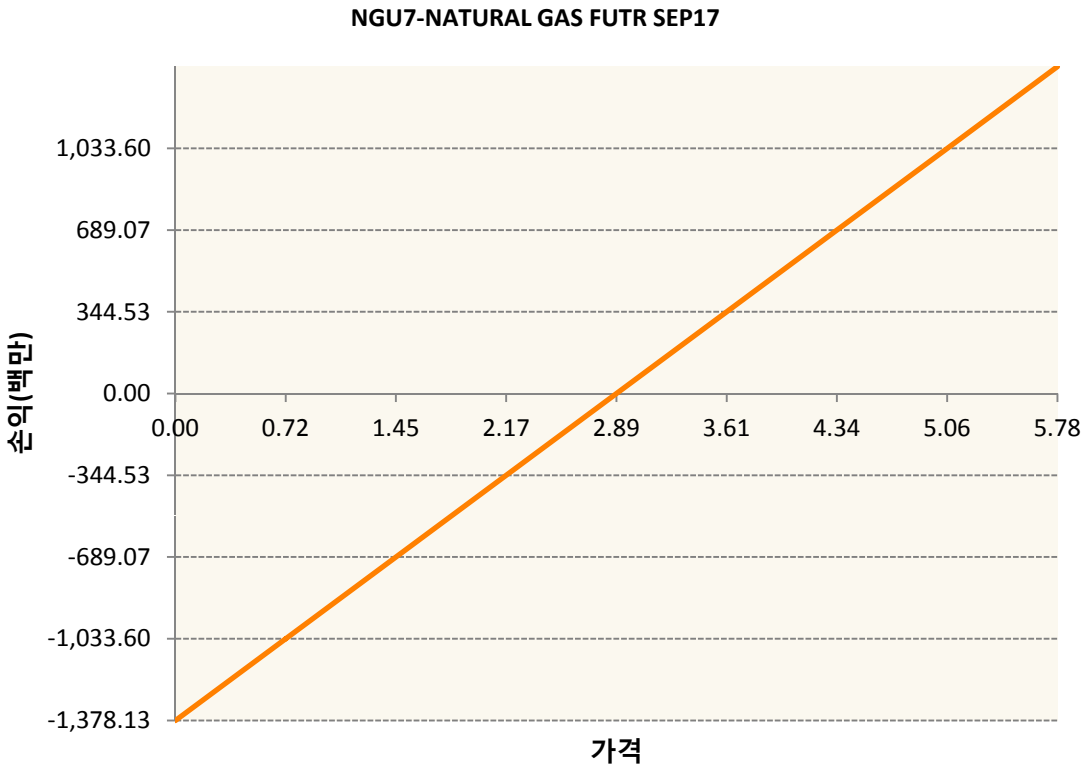
HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17

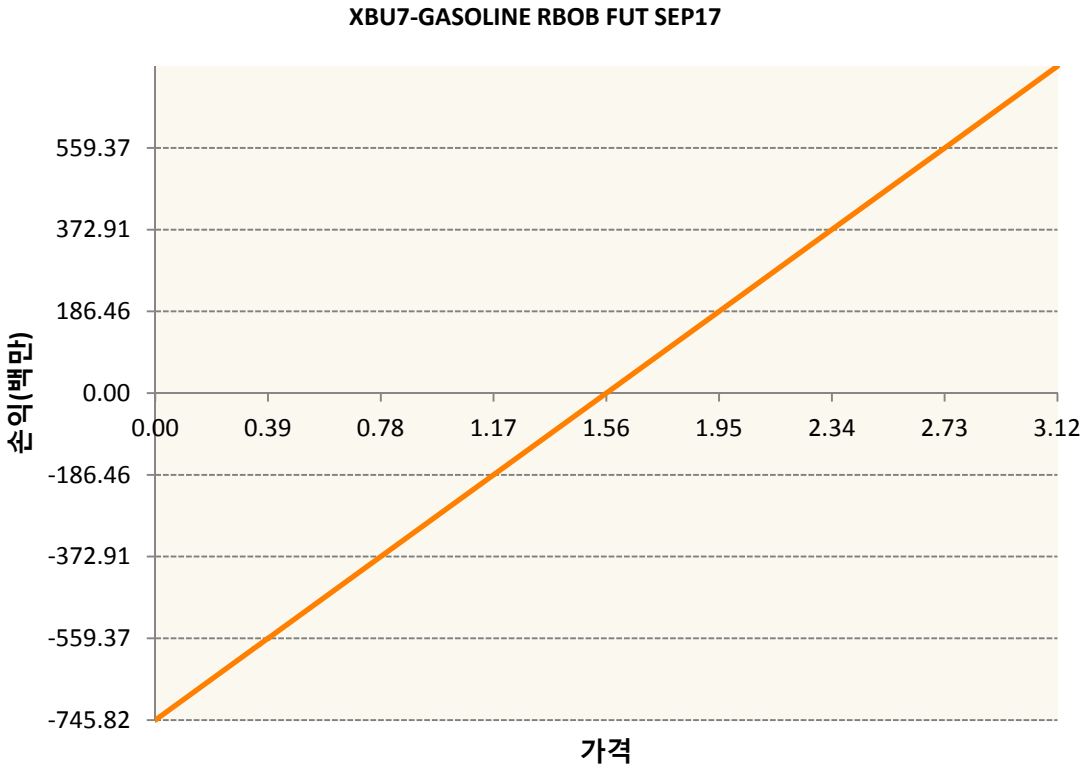


KR4175M80003-2017-08 달러선물




-341.19
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
손익(백만)
1,033.60
689.07
344.53
0.00
-344.53
-689.07
-1,033.60
-1,378.13
0.00
0.72
1.45
2.17
2.89
3.61
4.34
5.06
5.78
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
손익(백만)
559.37
372.91
186.46
0.00
-186.46
-372.91
-559.37
-745.82
0.00
0.39
0.78
1.17
1.56
1.95
2.34
2.73
3.12
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	76
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	114
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	60
KR4175M80(	2017-08 달러선물	27
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	110
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	60

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

753

공시일	2017-08-18
기준일	2017-08-17

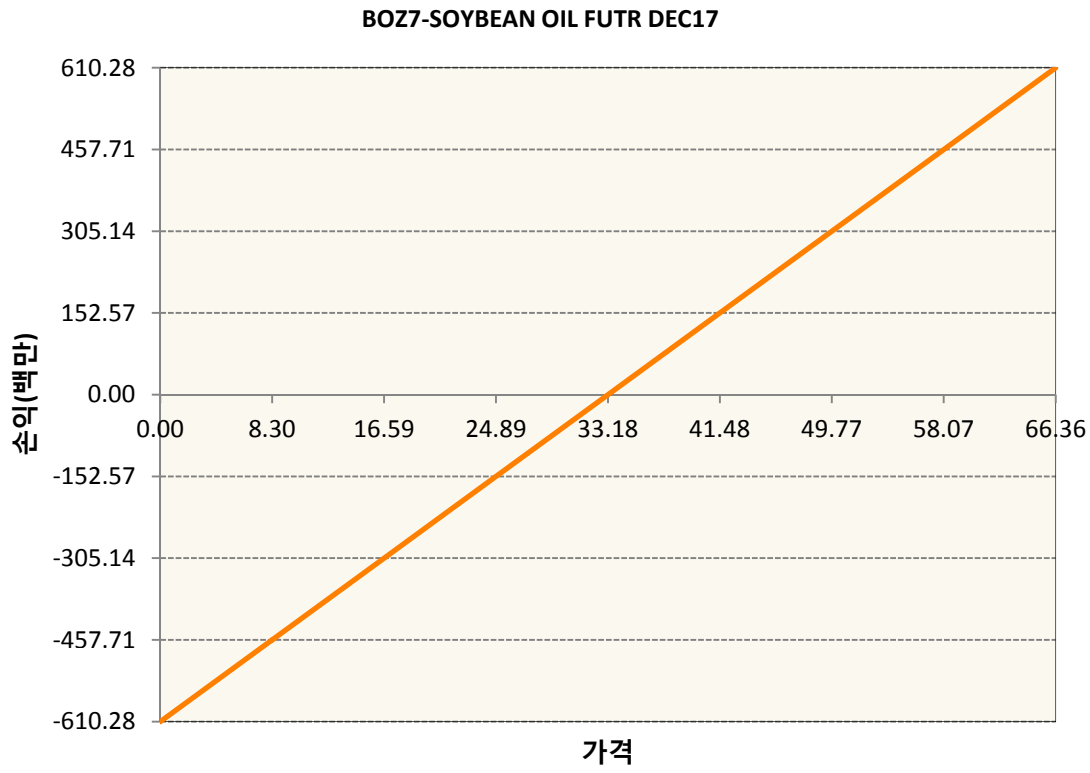
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

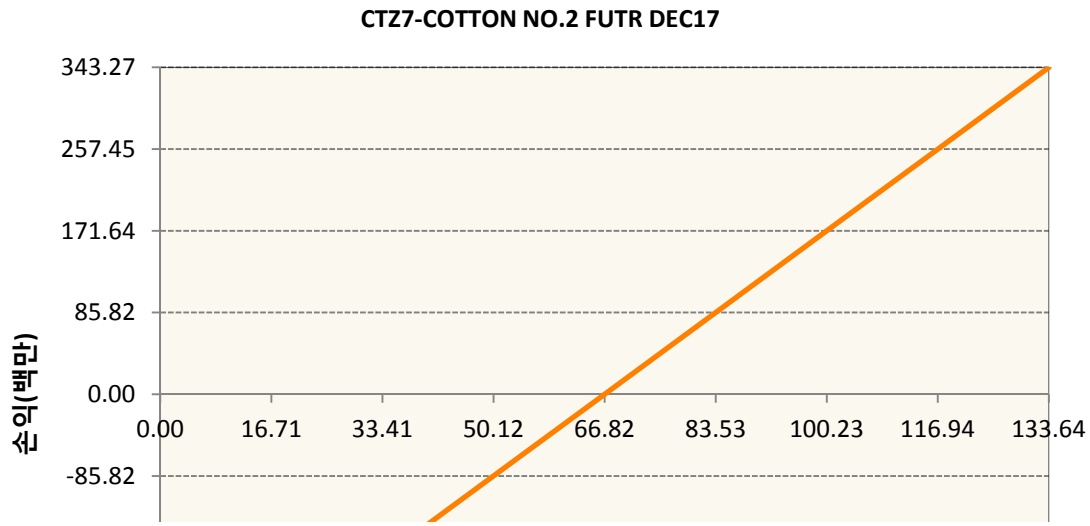
1. 계약금액

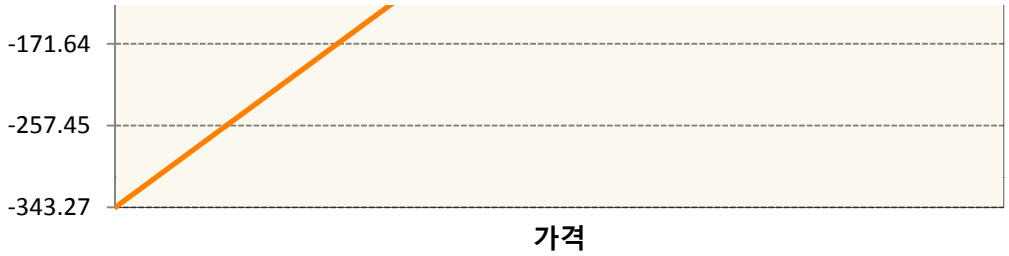
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,736	398	6,338	

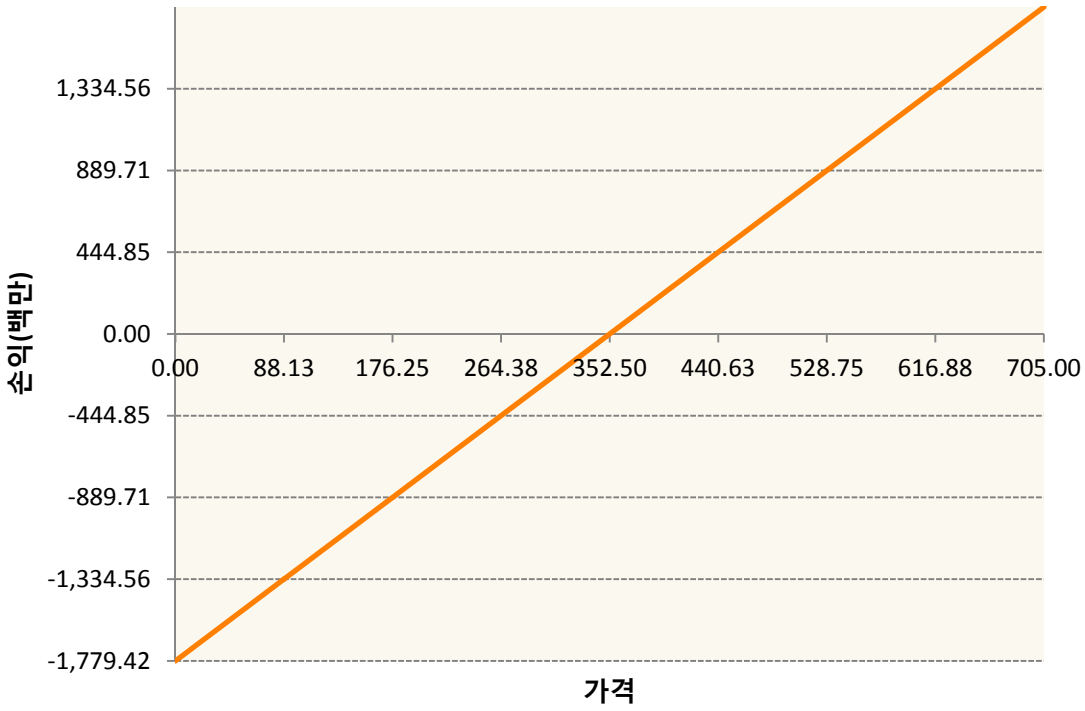
2. 만기시점의 손익구조



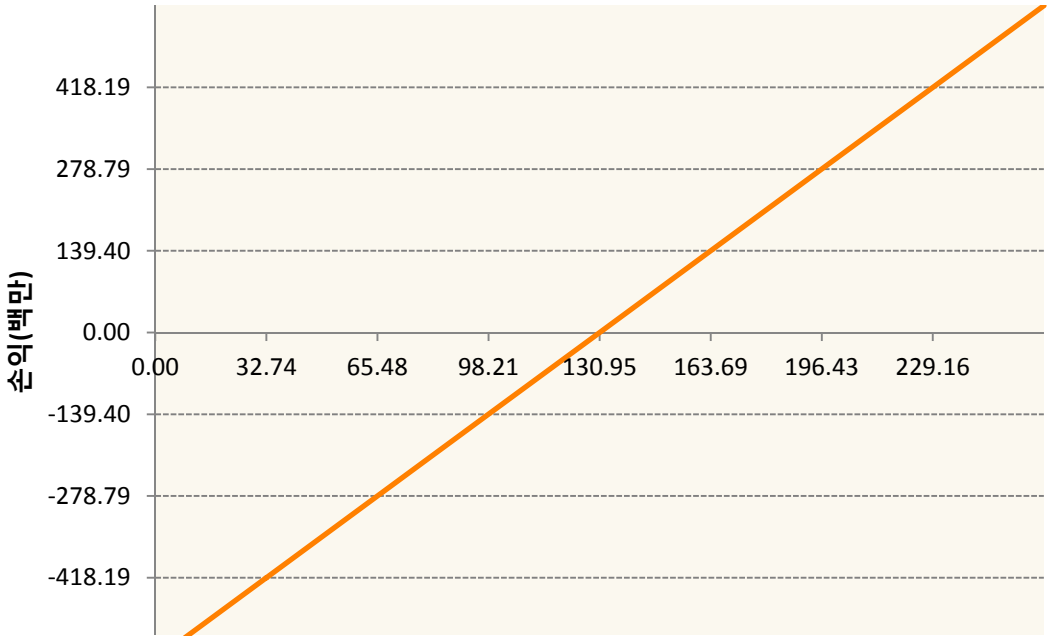


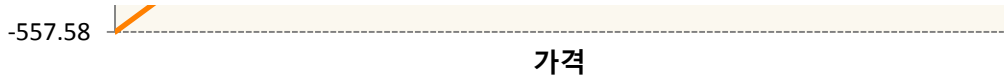


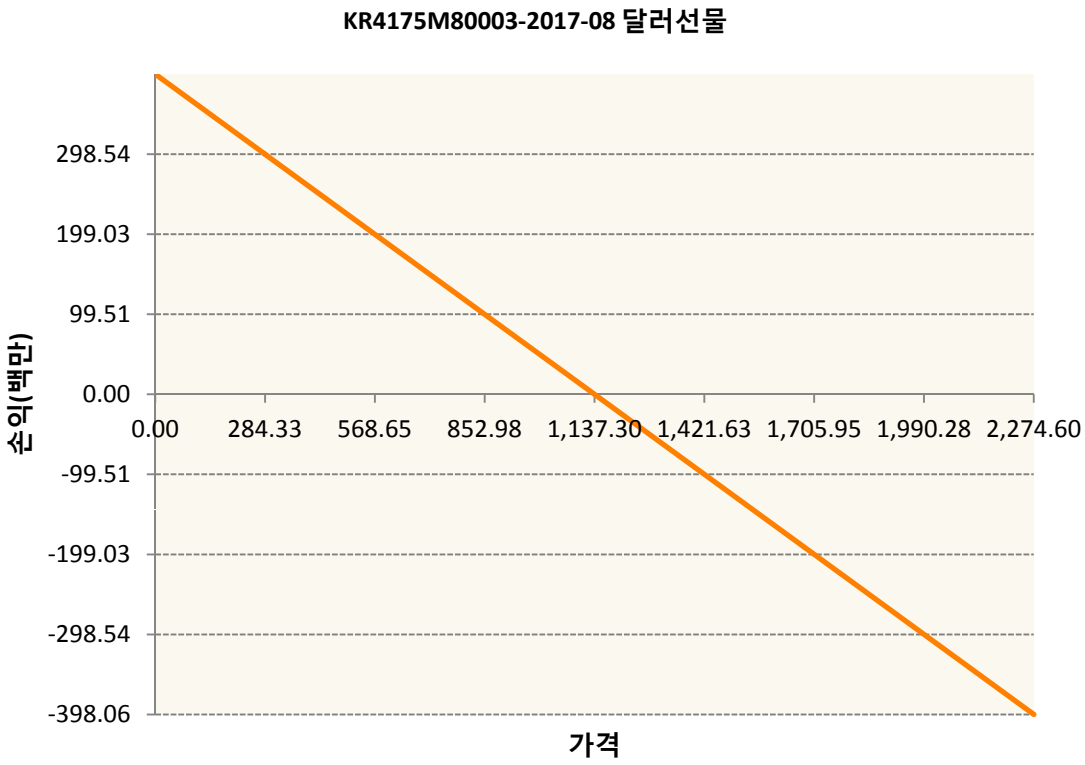
CU7-CORN FUTURE SEP17

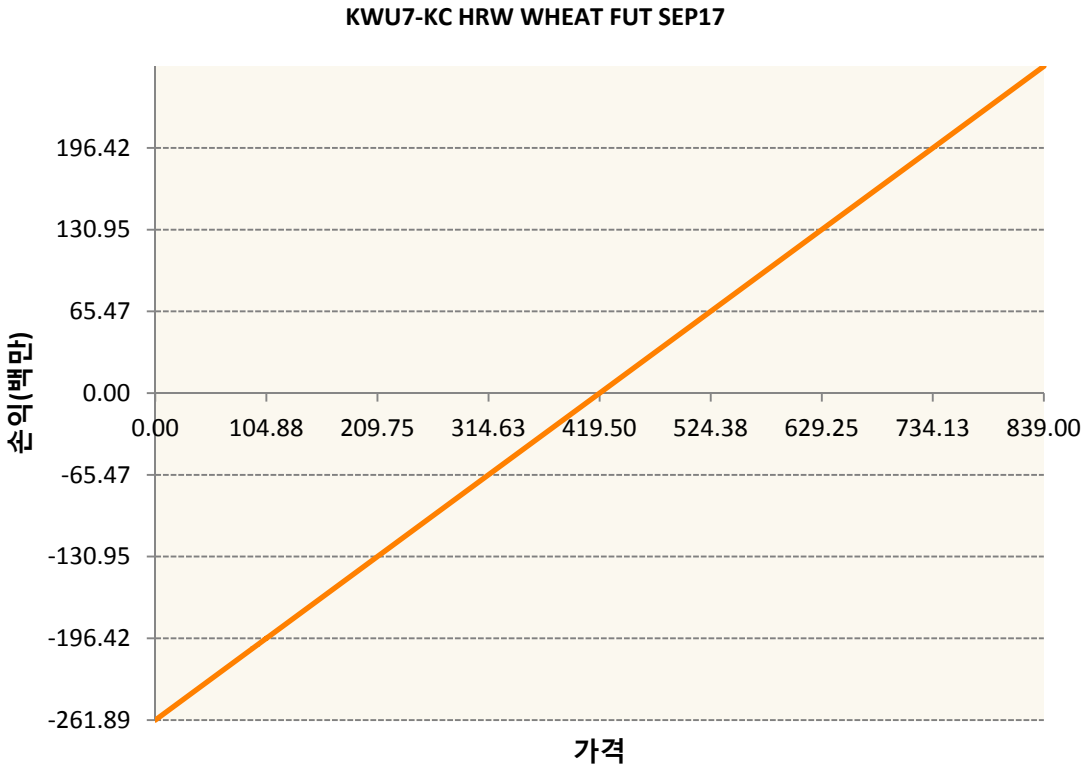


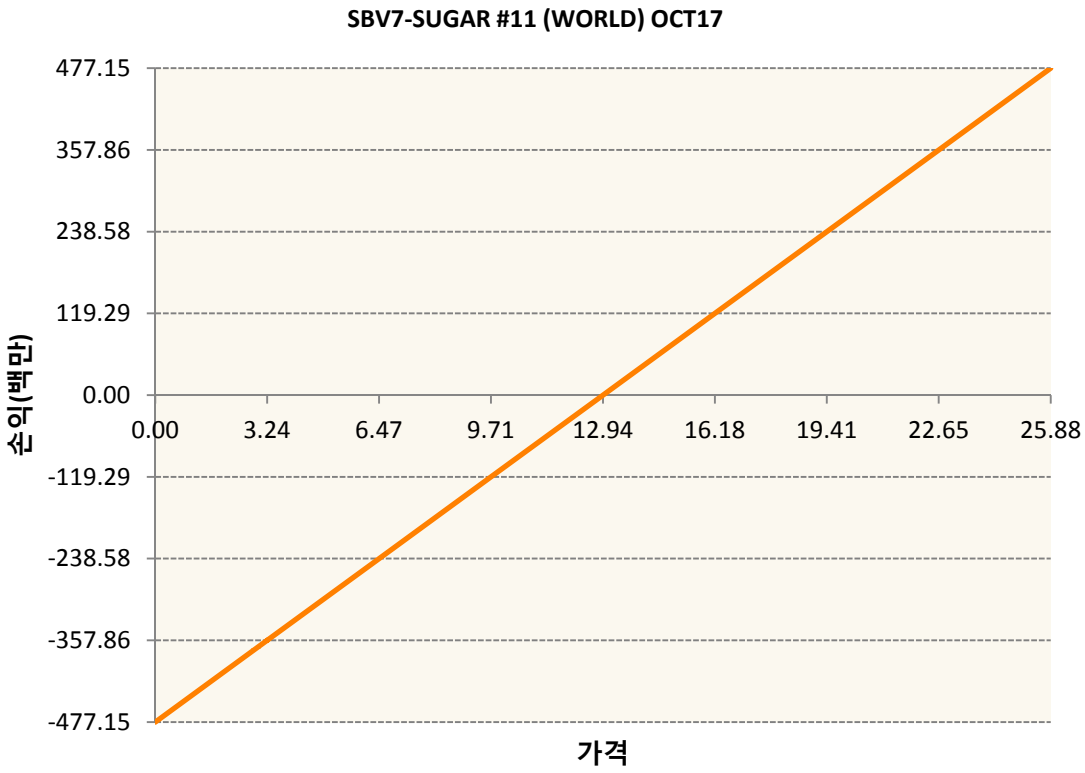
KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17

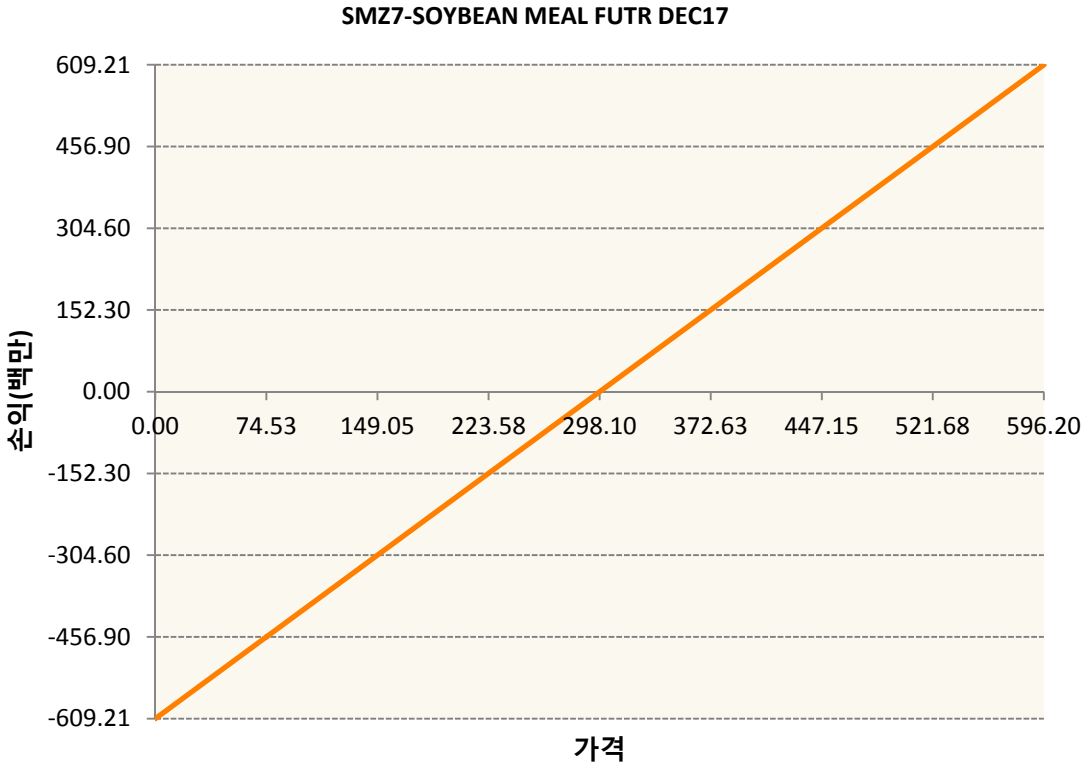



-557.58
가격

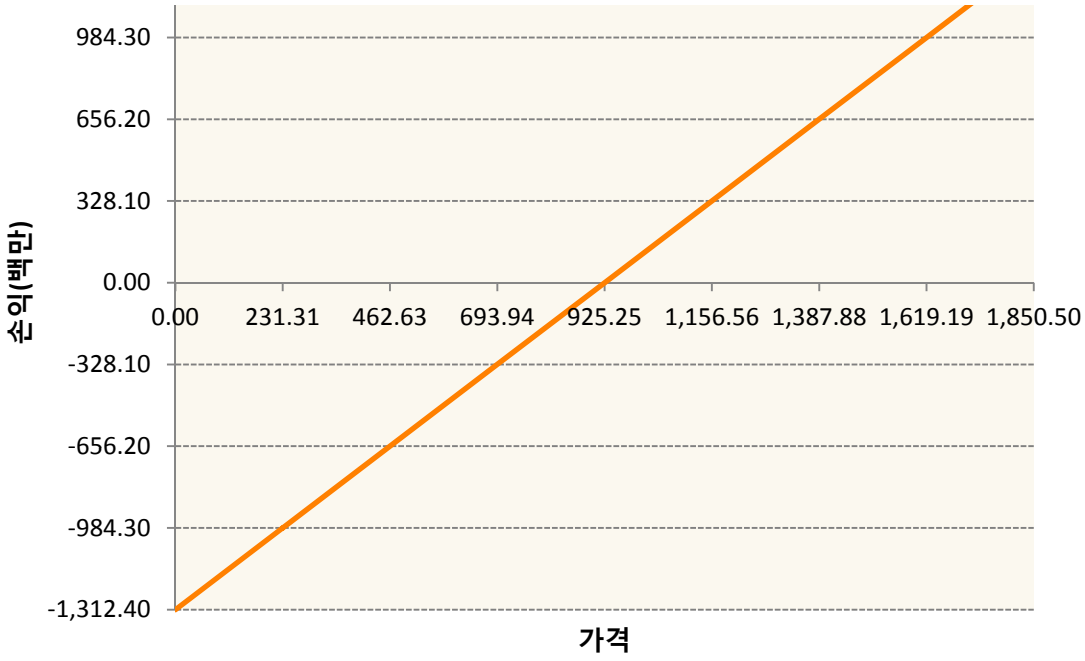

KR4175M80003-2017-08 달러선물
298.54
199.03
99.51
0.00
-99.51
-199.03
-298.54
-398.06
0.00
284.33
568.65
852.98
1,137.30
1,421.63
1,705.95
1,990.28
2,274.60
손익(백만)
가격

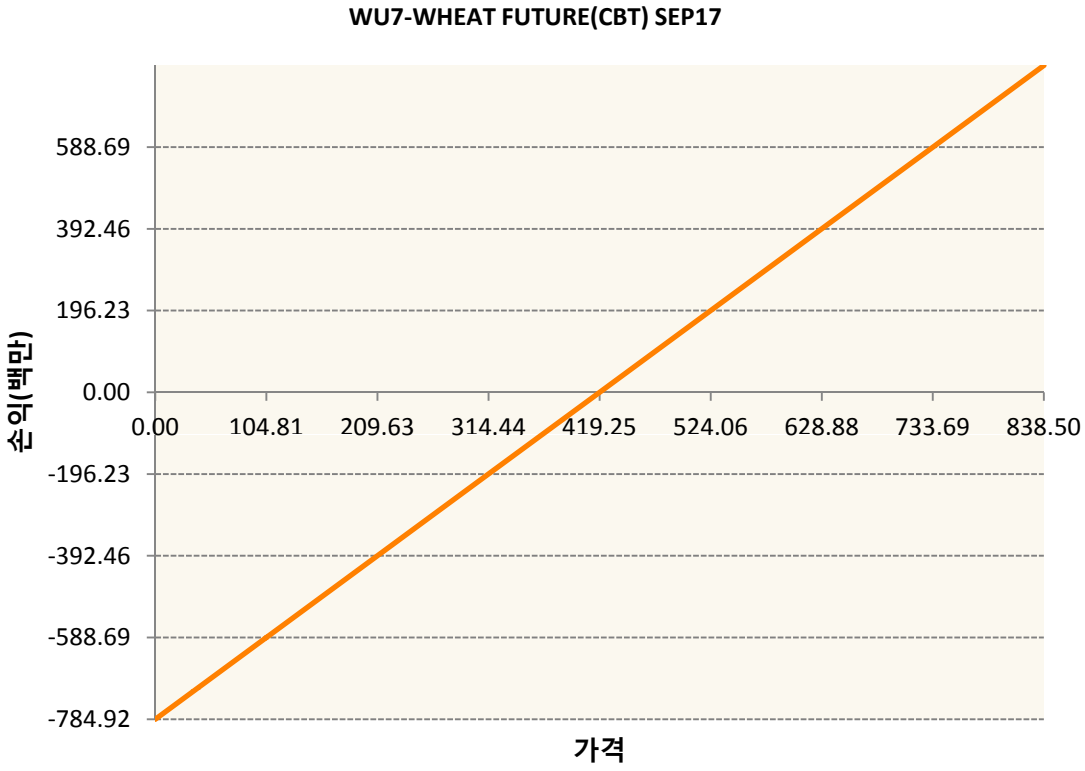

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
196.42
130.95
65.47
0.00
-65.47
-130.95
-196.42
-261.89
0.00
104.88
209.75
314.63
419.50
524.38
629.25
734.13
839.00
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
477.15
357.86
238.58
119.29
0.00
-119.29
-238.58
-357.86
-477.15
0.00
3.24
6.47
9.71
12.94
16.18
19.41
22.65
25.88
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
609.21
456.90
304.60
152.30
0.00
-152.30
-304.60
-456.90
-609.21
0.00
74.53
149.05
223.58
298.10
372.63
447.15
521.68
596.20
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	49
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	27
CU7	CORN FUTURE SEP17	142
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	45
KR4175M80(	2017-08 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	21
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	38
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	49
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	105
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	63

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

638